

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

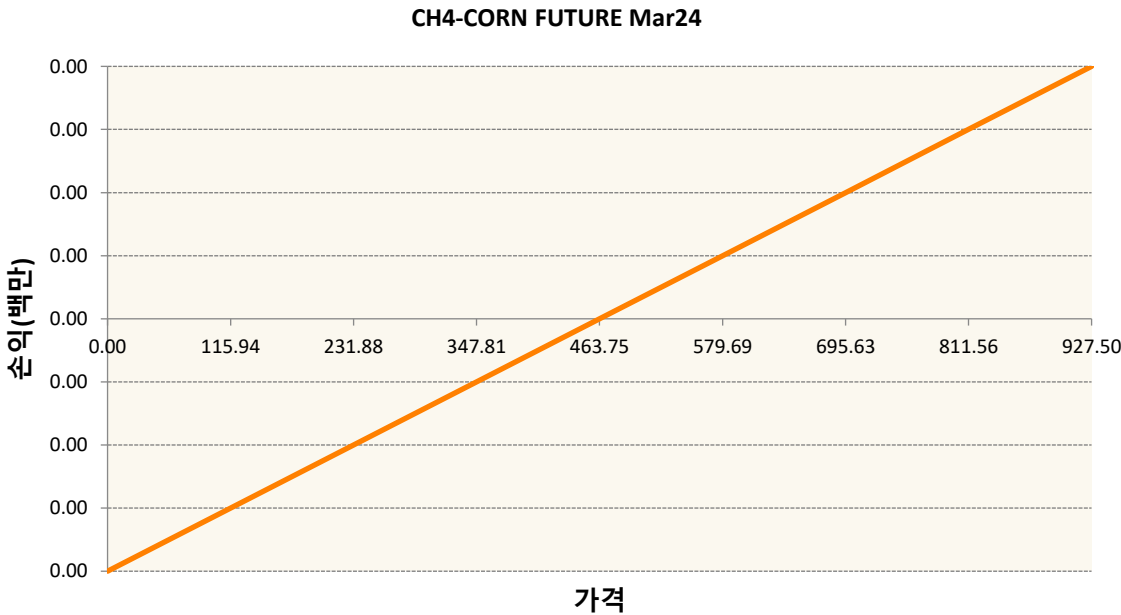
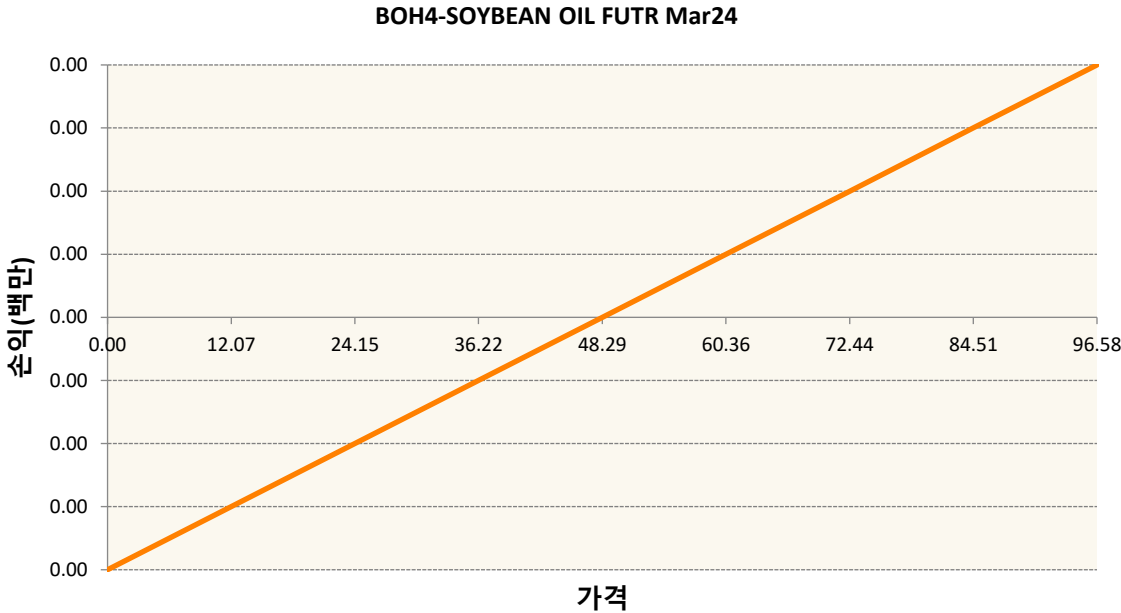
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

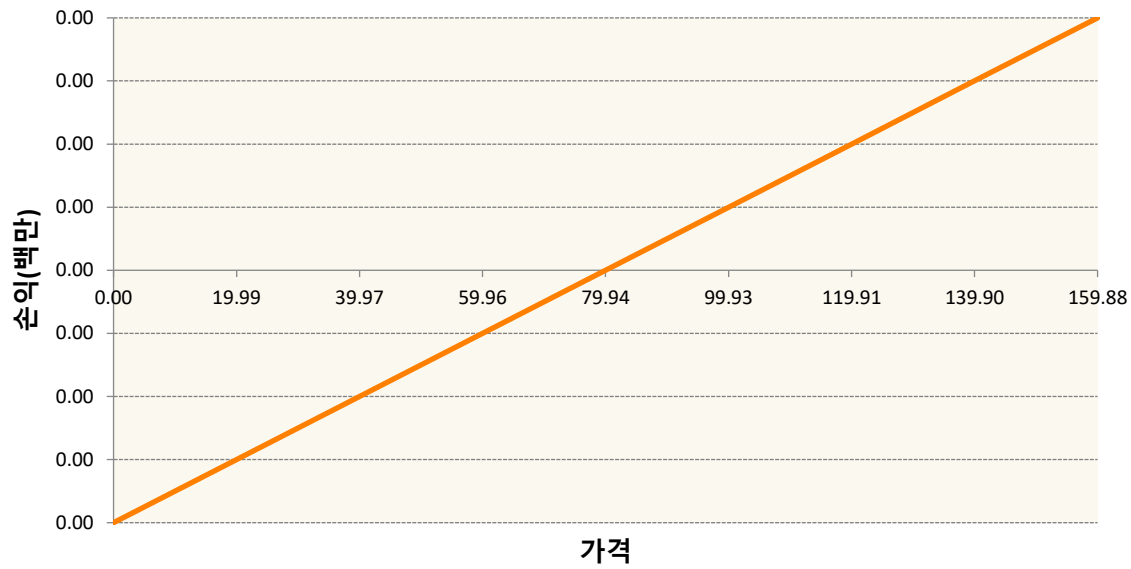
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,611	0	4,611	
누계	통화	선물	0	483	-483	장내

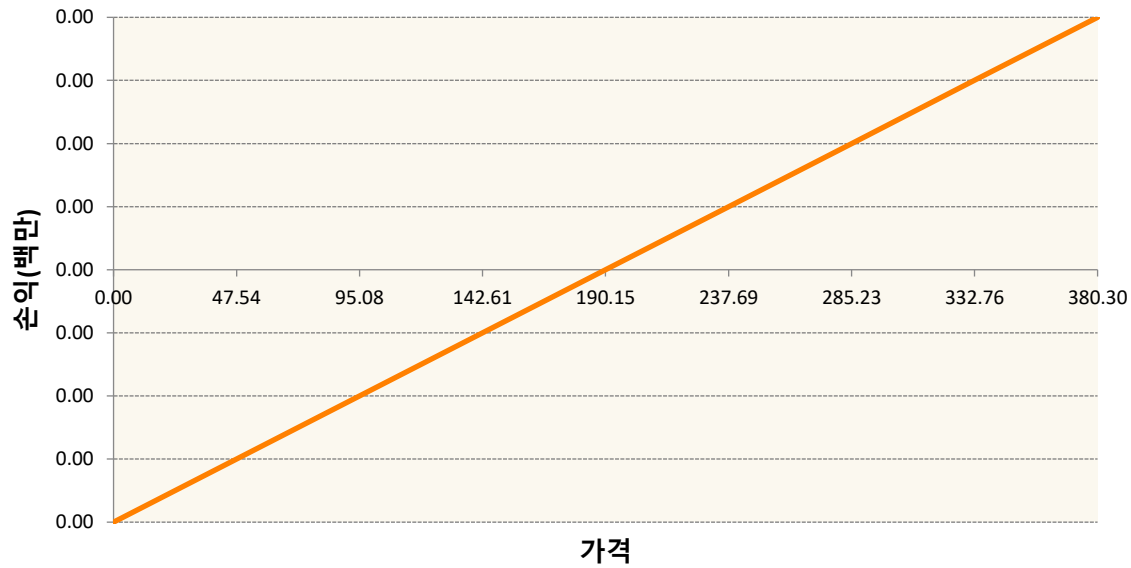
2. 만기시점의 손익구조



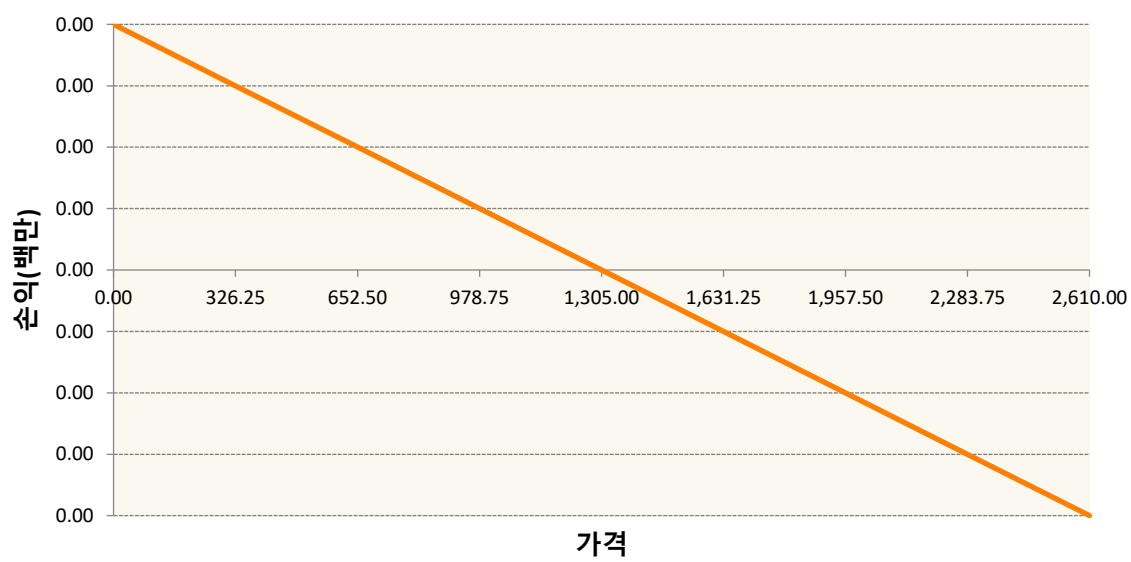
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



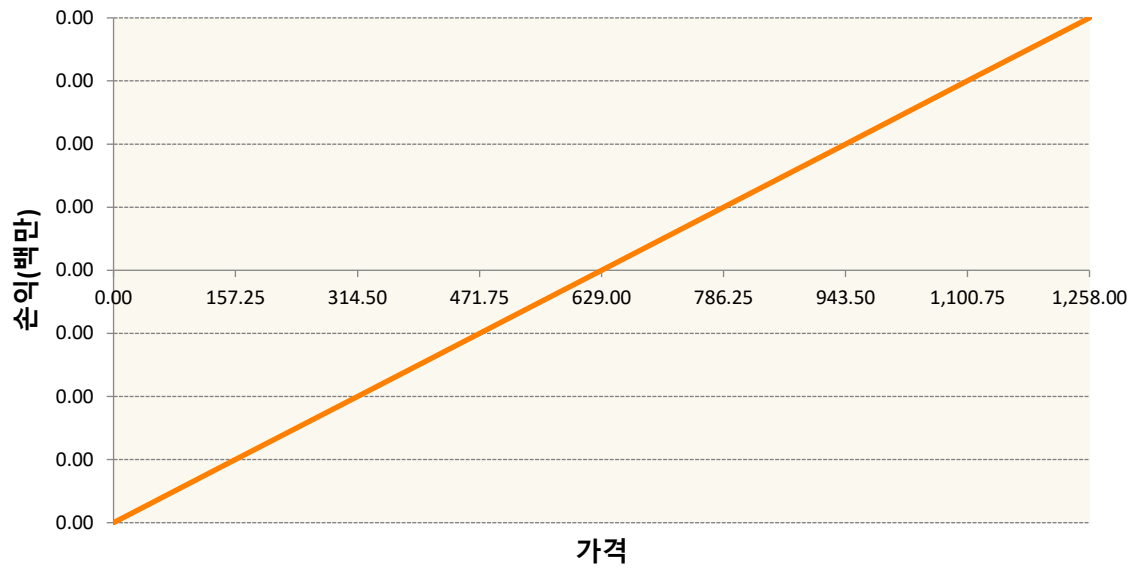
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



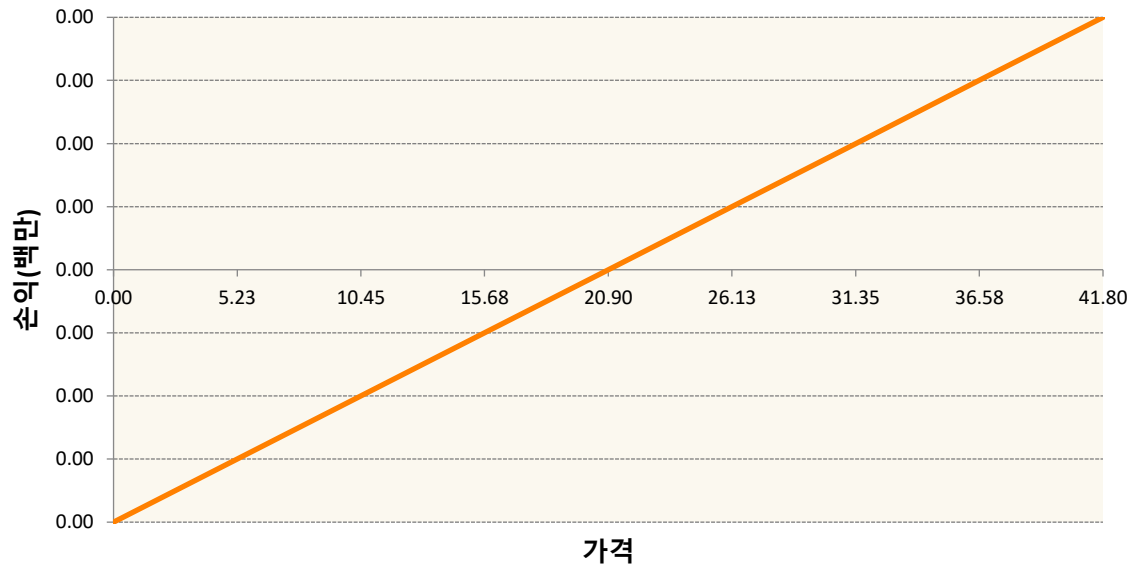
KR4175V10001-2024-01 달러선물



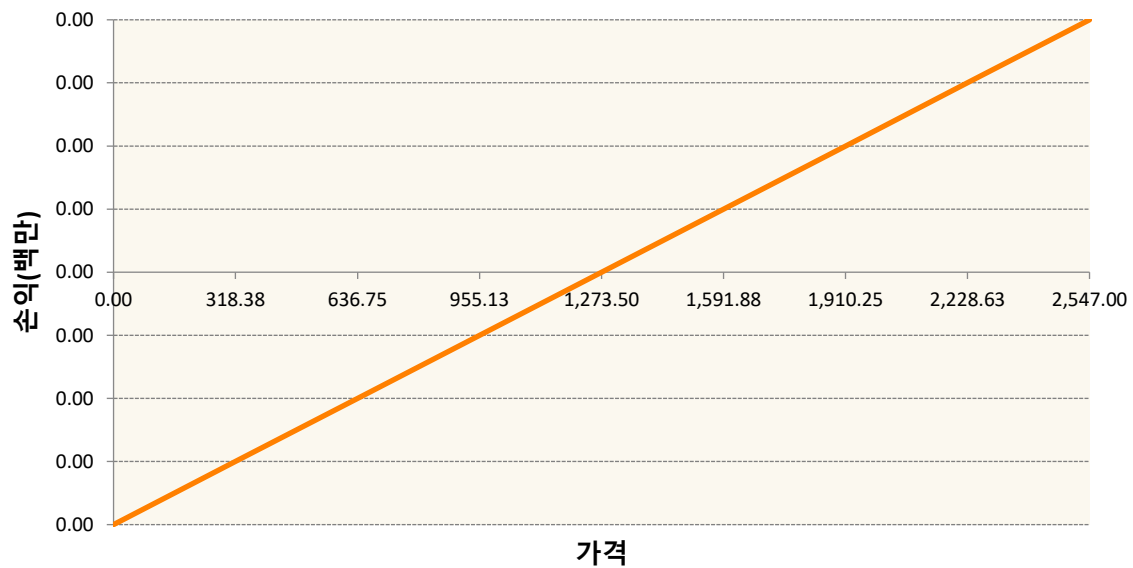
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



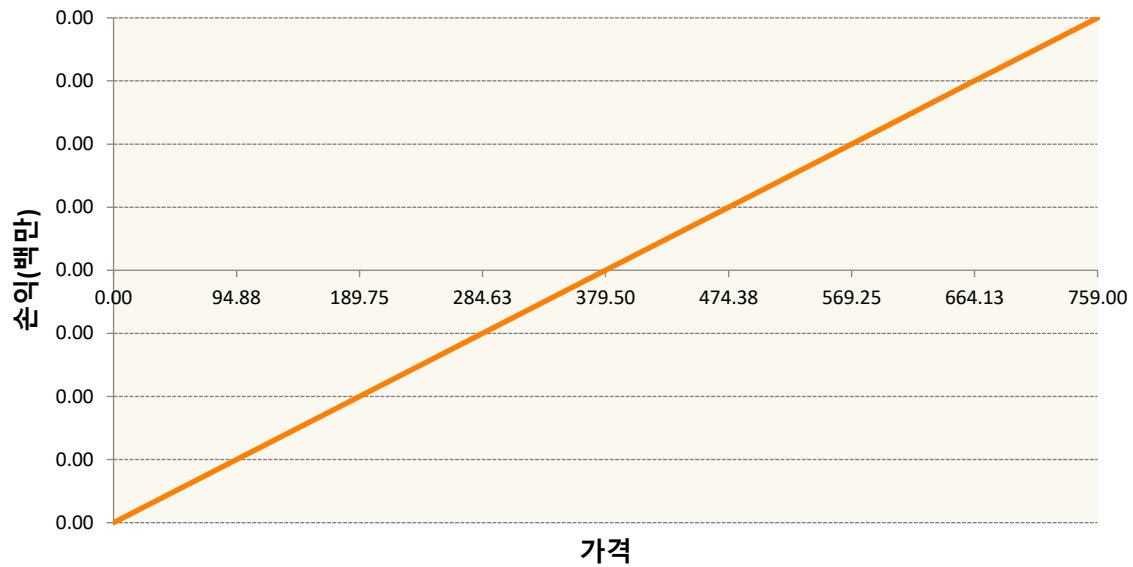
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



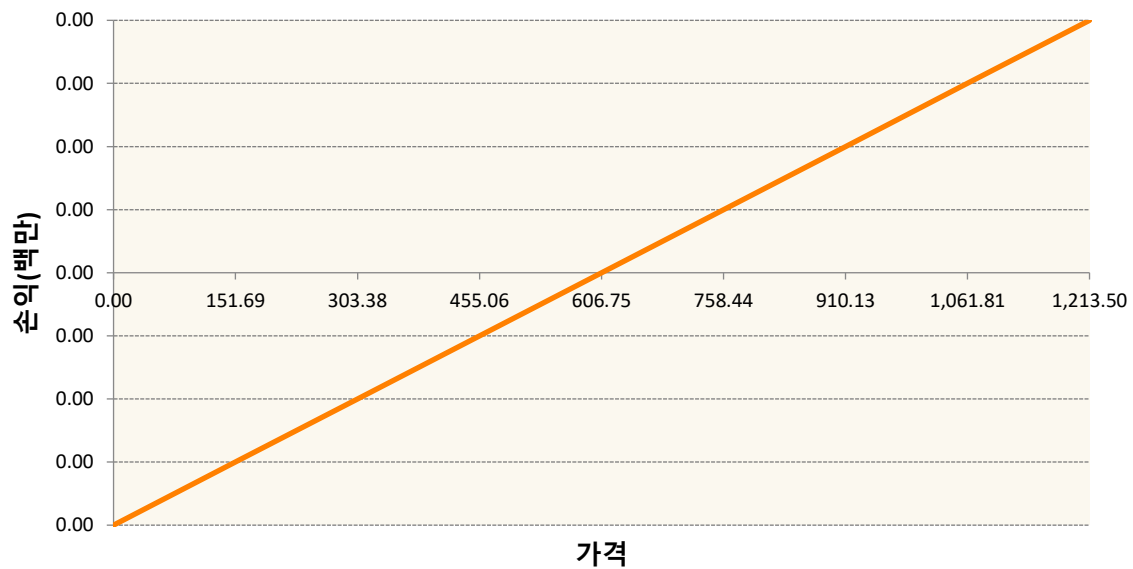
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



SMH4-SOYBEAN MEAL FUTR Mar24



WH4-WHEAT FUTURE(CBT) Mar24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

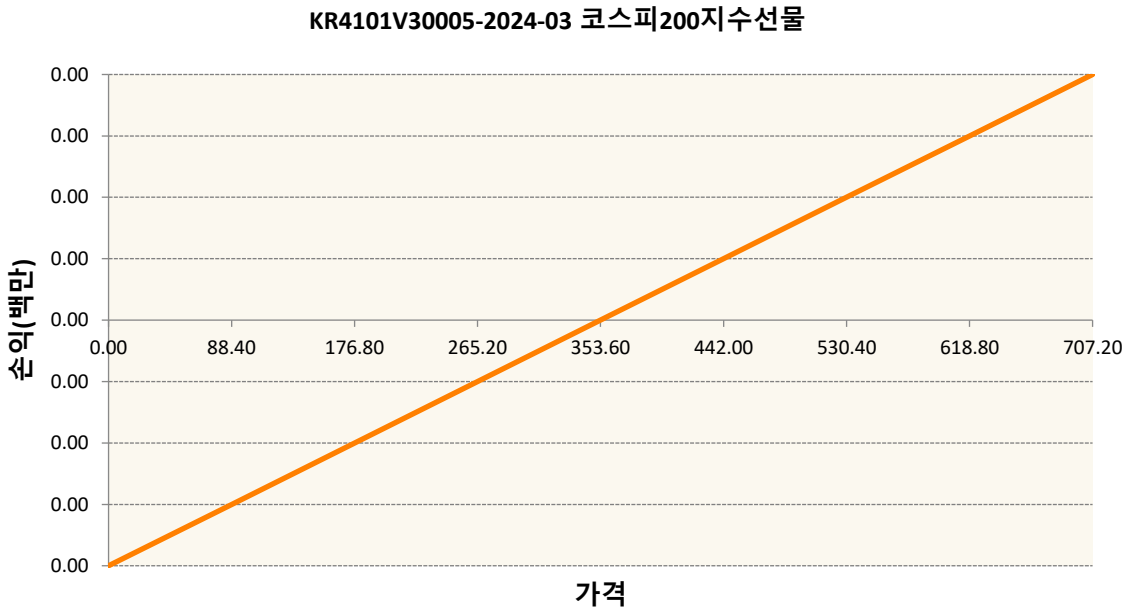
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,326	0	1,326	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,779	0	3,779	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래231226	307
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

270

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

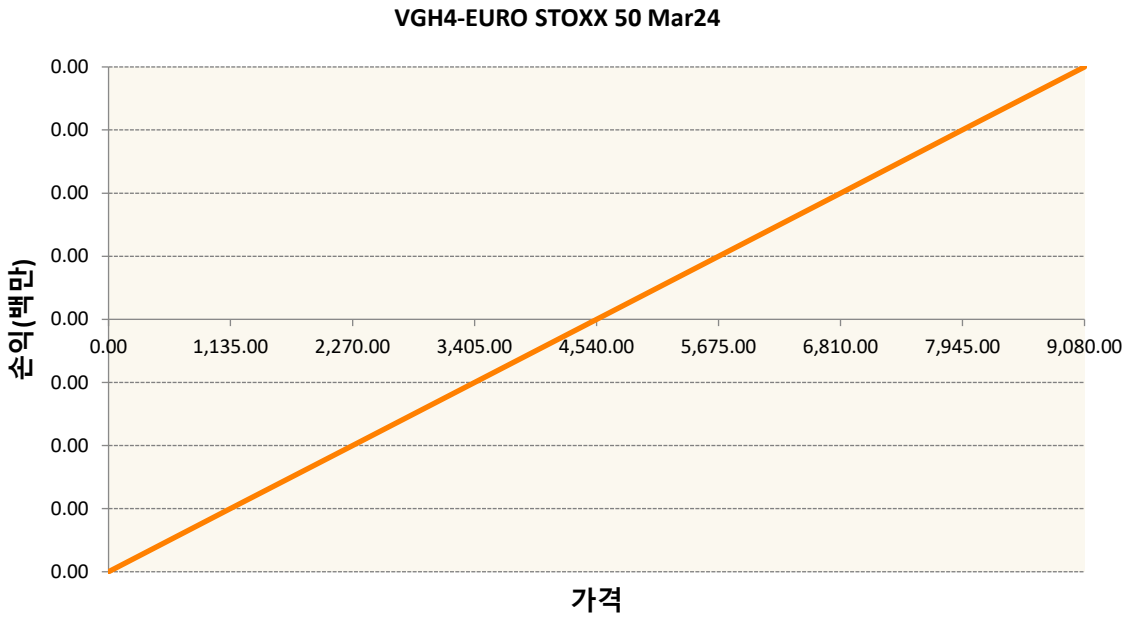
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	969	0	969	
누계	통화	선도	214	0	214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCL	EUR/KRW 22-03-24E	17
VGH4	EURO STOXX 50 Mar24	78

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

72

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

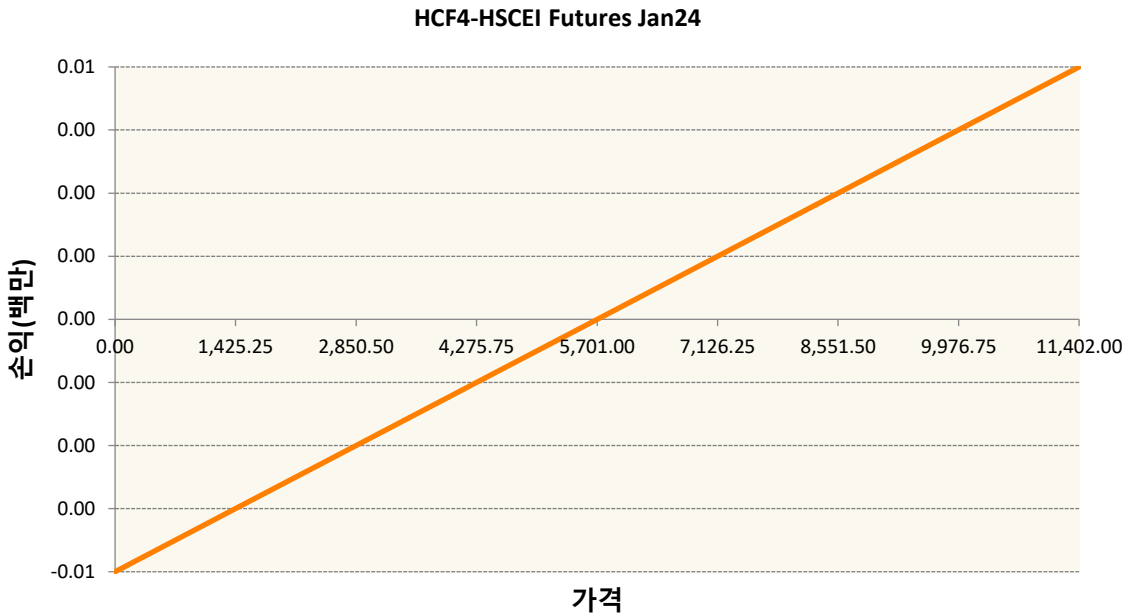
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,134	0	1,134	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF4	HSCEI Futures Jan24	91
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

132

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

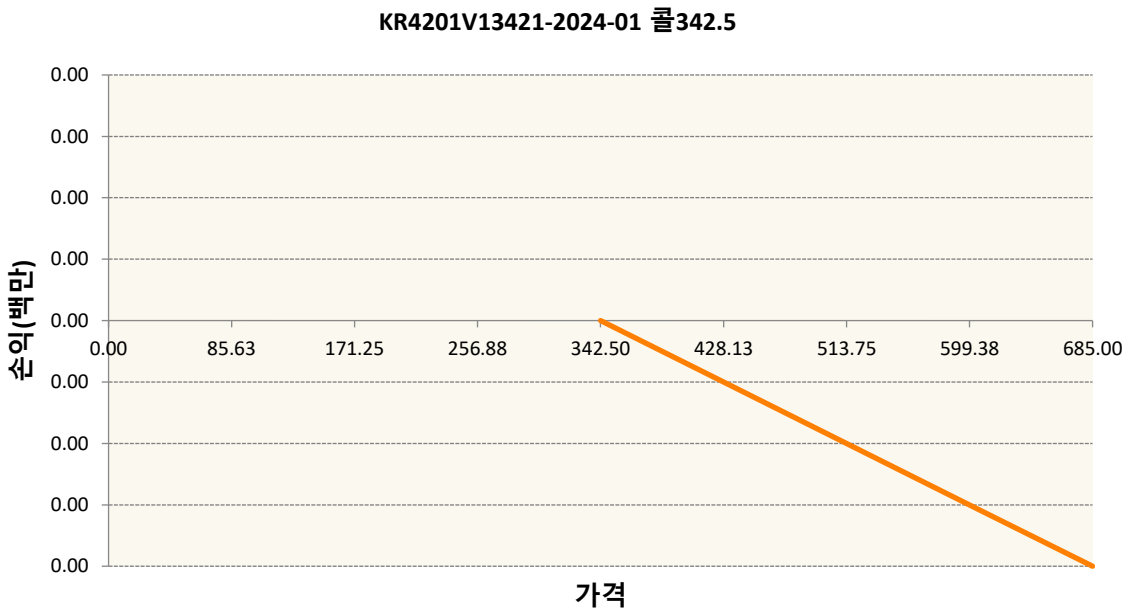
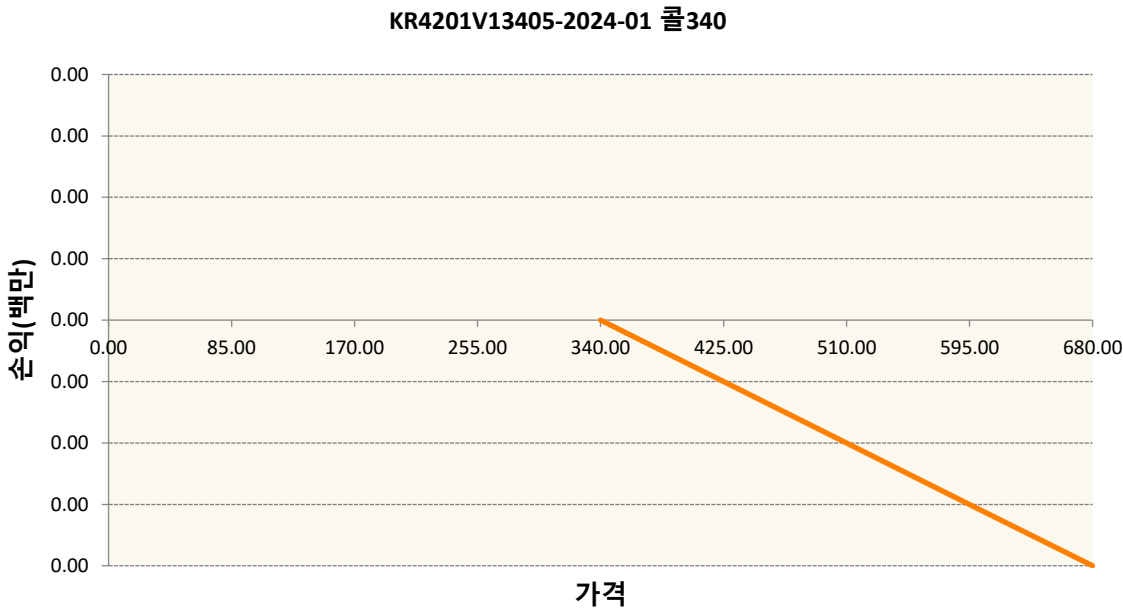
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

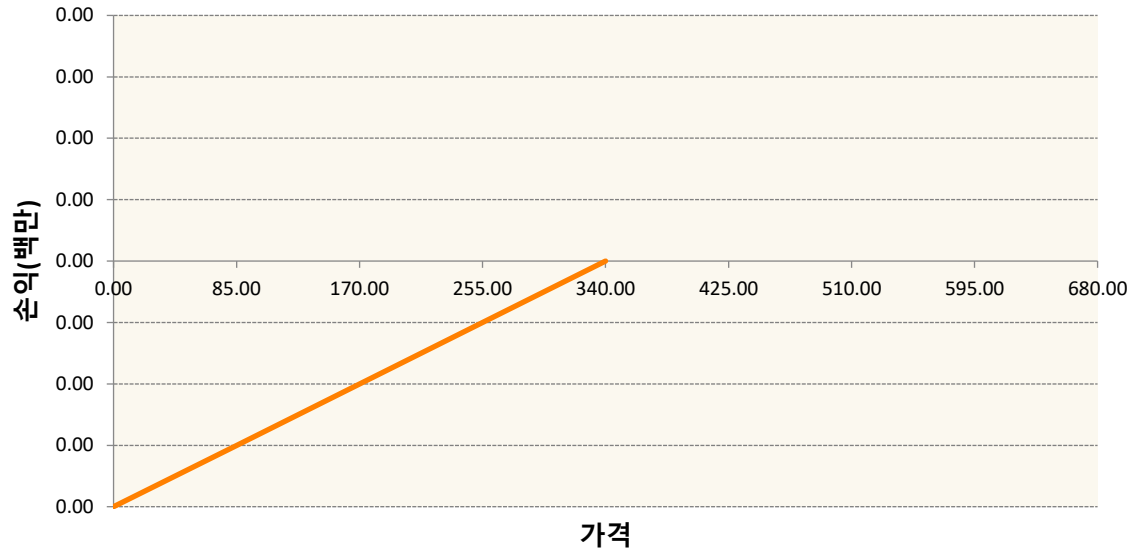
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,150	-49,150	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V13403-2024-01 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V13405			2024-01 콜340				1,143
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	547	541	535	527	518	508	497
-5.33%	497	482	466	450	433	416	399
-2.67%	335	316	297	277	258	239	220
0%	38	26	14	0	-14	-30	-45
2.67%	-338	-341	-346	-352	-360	-368	-377
5.33%	-737	-737	-738	-740	-743	-746	-750
8.00%	-1,139	-1,139	-1,139	-1,140	-1,140	-1,141	-1,143
KR4201V13421			2024-01 콜342.5				1,978
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	828	822	814	803	790	776	760
-5.33%	770	748	724	699	672	645	617
-2.67%	546	512	478	443	409	374	340
0%	80	55	28	0	-29	-59	-89
2.67%	-558	-568	-579	-593	-610	-628	-648
5.33%	-1,257	-1,259	-1,262	-1,267	-1,273	-1,281	-1,291
8.00%	-1,968	-1,968	-1,968	-1,969	-1,971	-1,974	-1,978
KR4301V13403			2024-01 풋340				415
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-406	-406	-407	-408	-410	-412	-415
-5.33%	-184	-189	-194	-200	-206	-212	-218
-2.67%	-35	-43	-51	-58	-66	-74	-82
0%	10	7	4	0	-4	-9	-14

2.67%	14	14	13	13	12	10	9
5.33%	14	14	14	14	14	14	13
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

3,814

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,956	0	1,956	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	4,537	0	4,537	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	17,704	0	17,704	
누계	통화	선도	0	17,386	-17,386	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E	186
FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E	641
FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E	26
FXW213DCS KRW/USD 31-01-24E	31
FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E	506
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

721

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

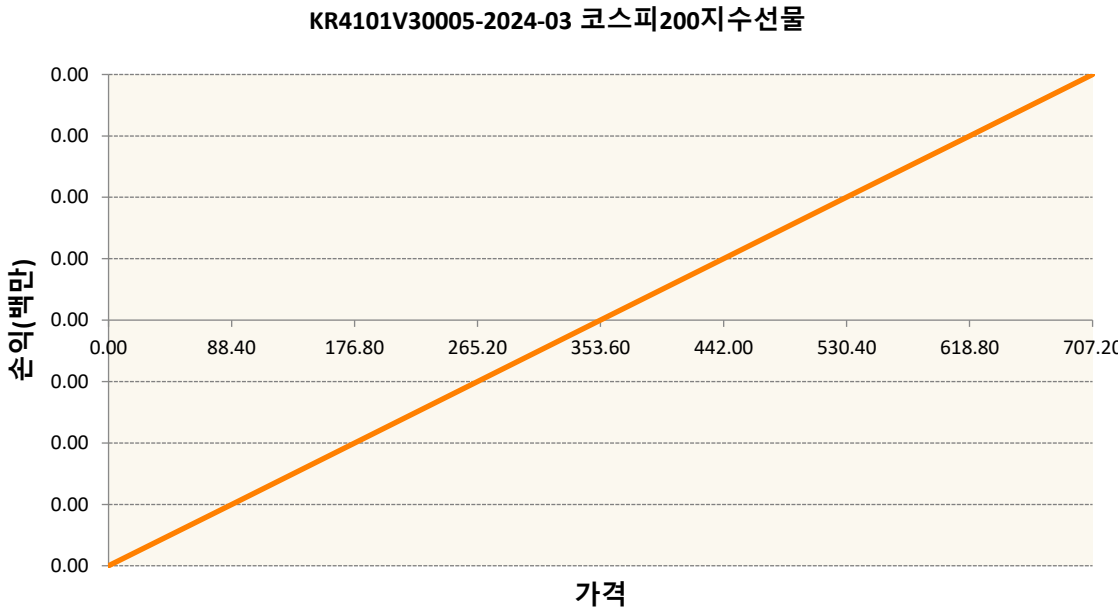
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	530	0	530	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					42
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

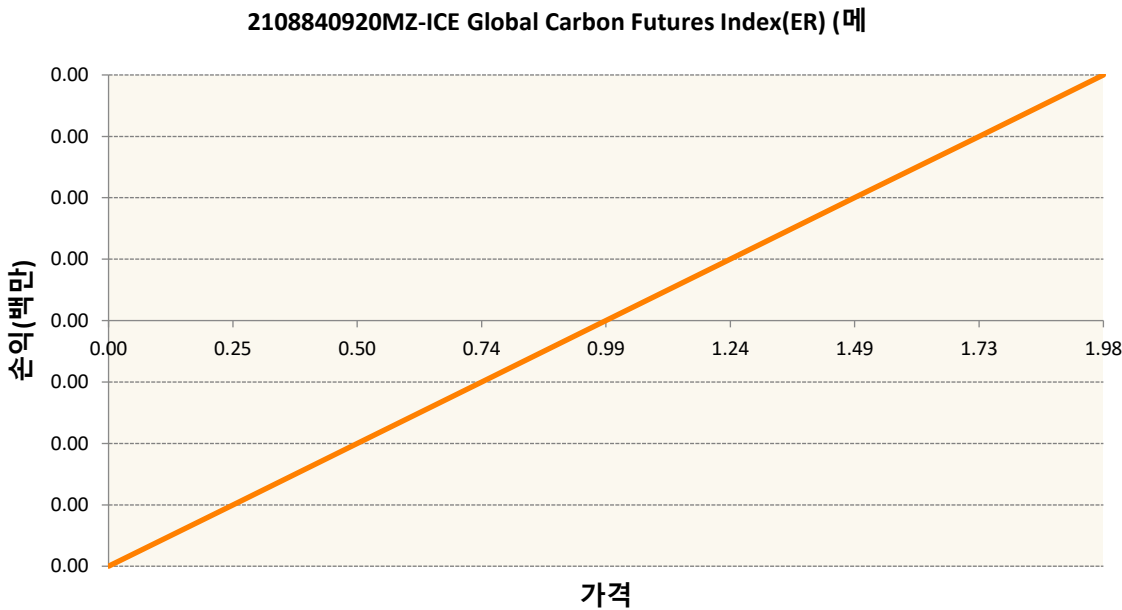
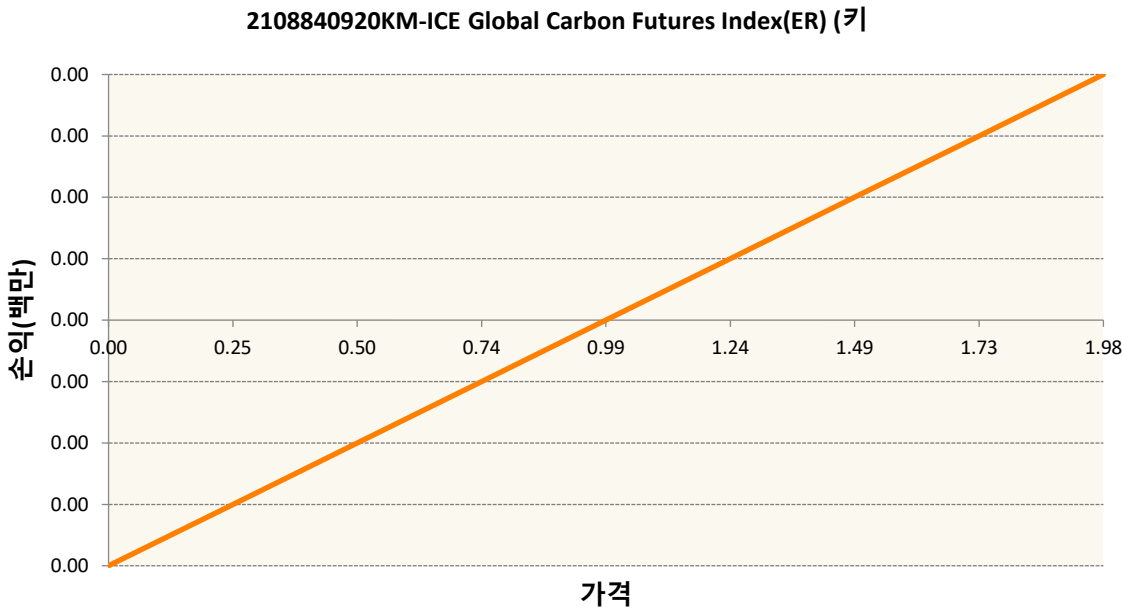
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

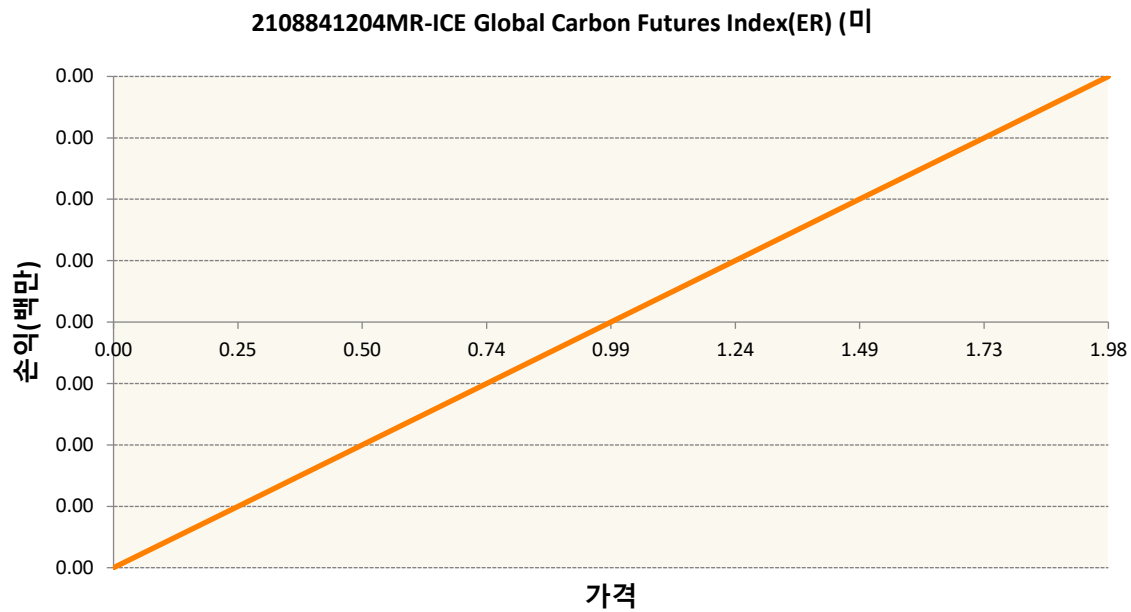
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	19,672	0	19,672	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		980
2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		196
2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		392

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,999

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

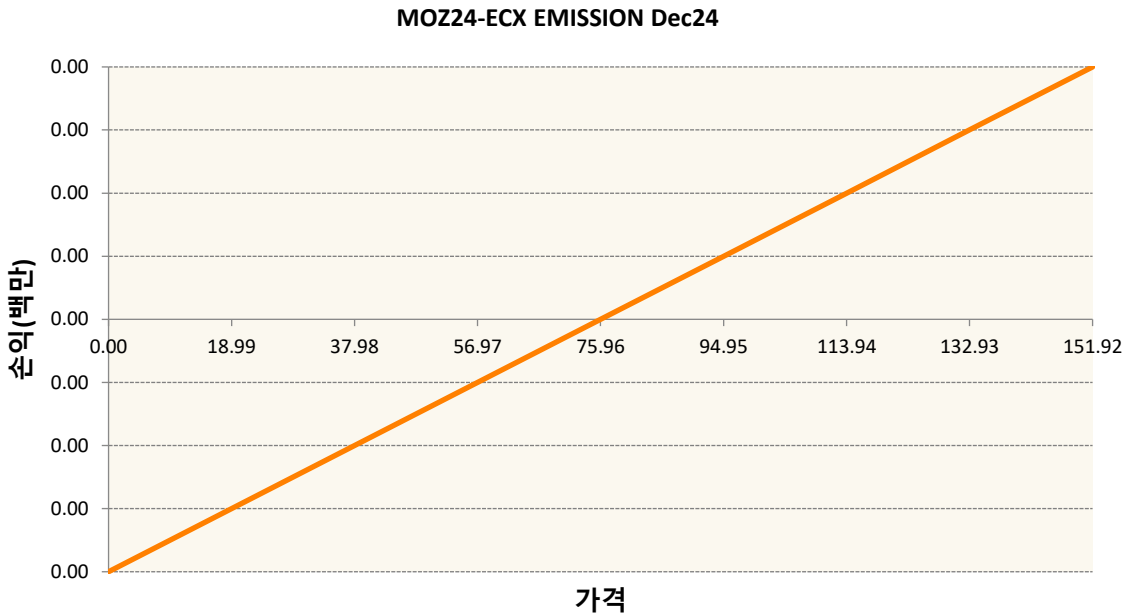
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,316	0	9,316	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	2,405	-2,405	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	15
FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	62
FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	115
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	745
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,478

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,370	0	4,370	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

46

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,244	0	6,244	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(미래)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

5

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

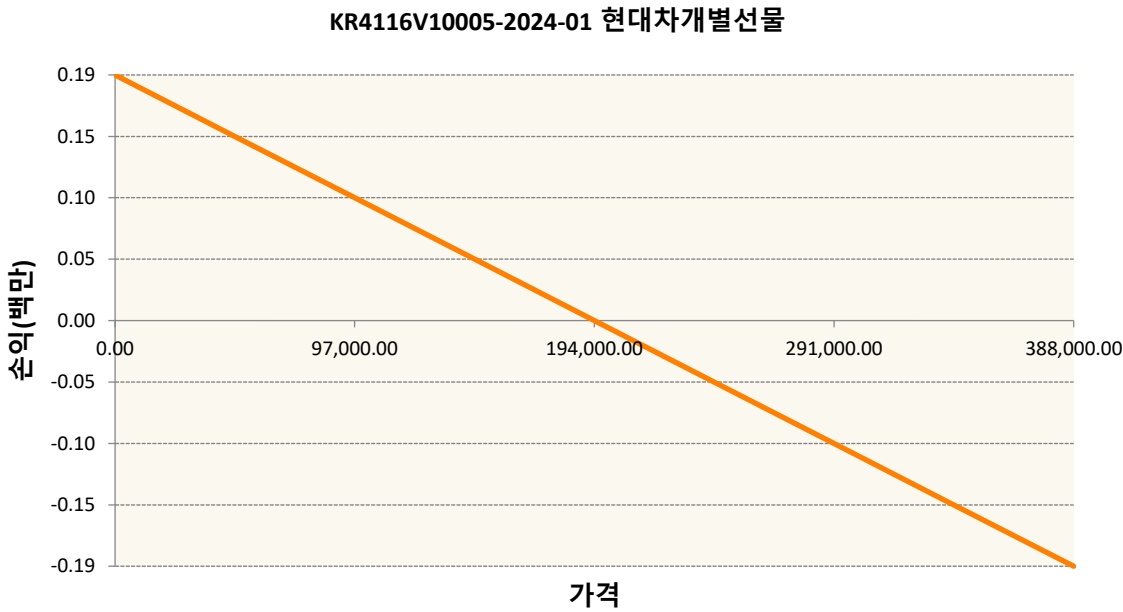
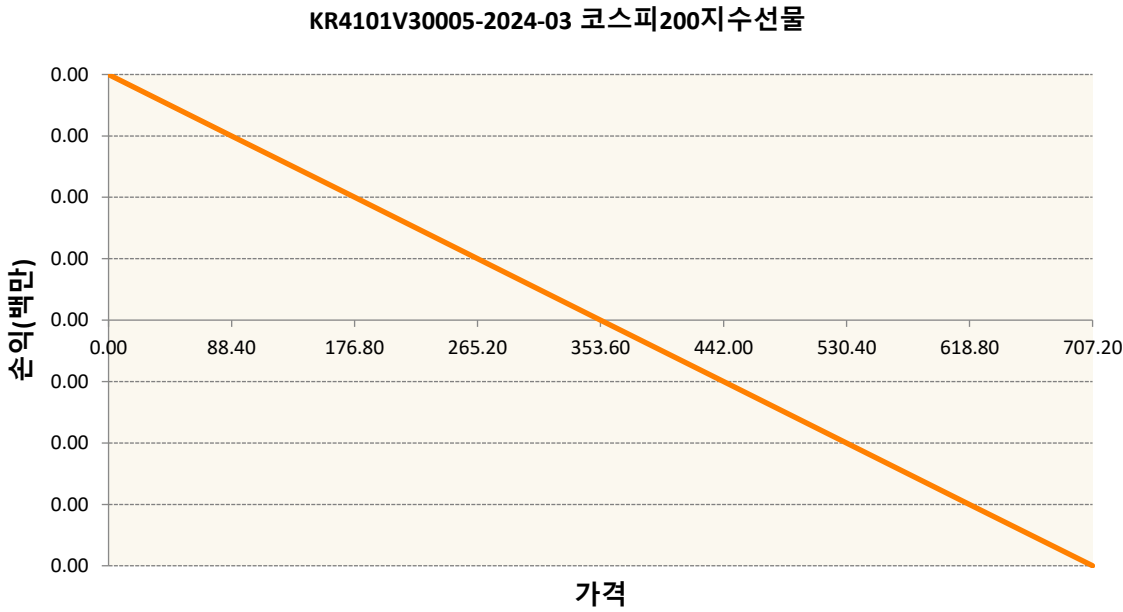
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

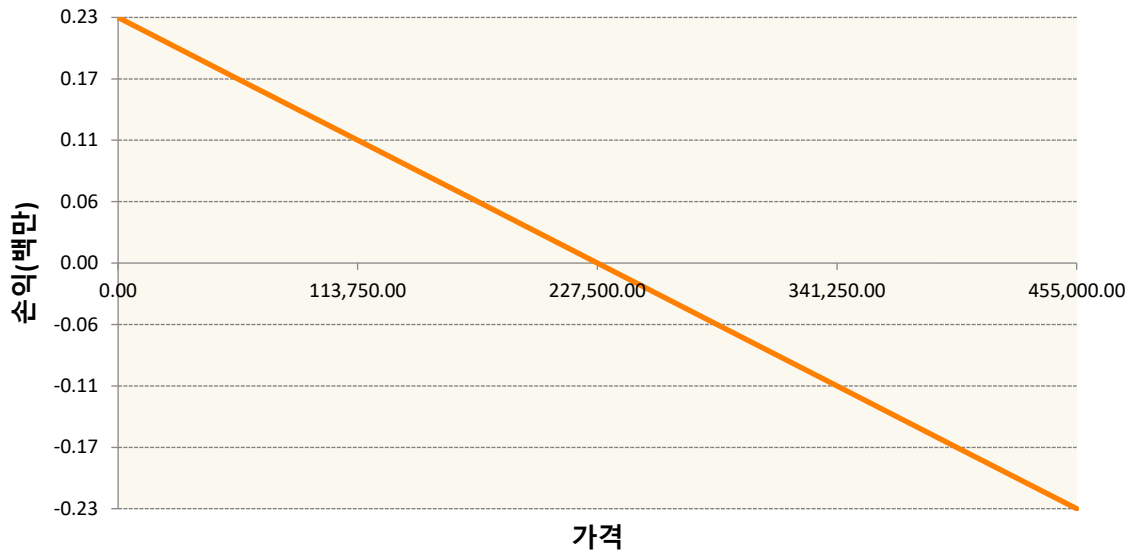
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8	0	8	장내
누계	유가증권	선물	28	1,515	-1,487	장내

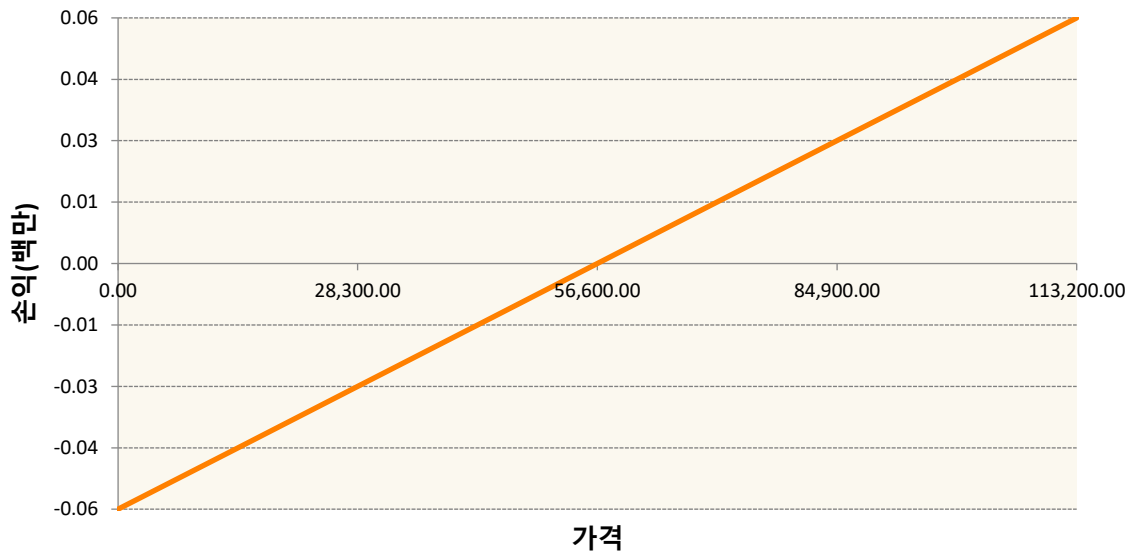
2. 만기시점의 손익구조



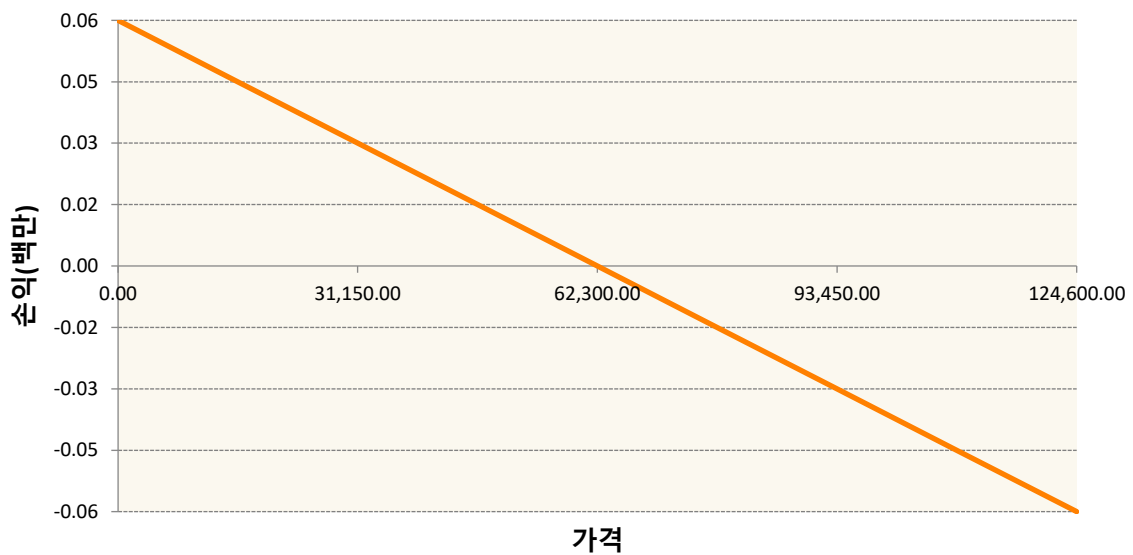
KR4120V10007-2024-01 현대모비스개별선물



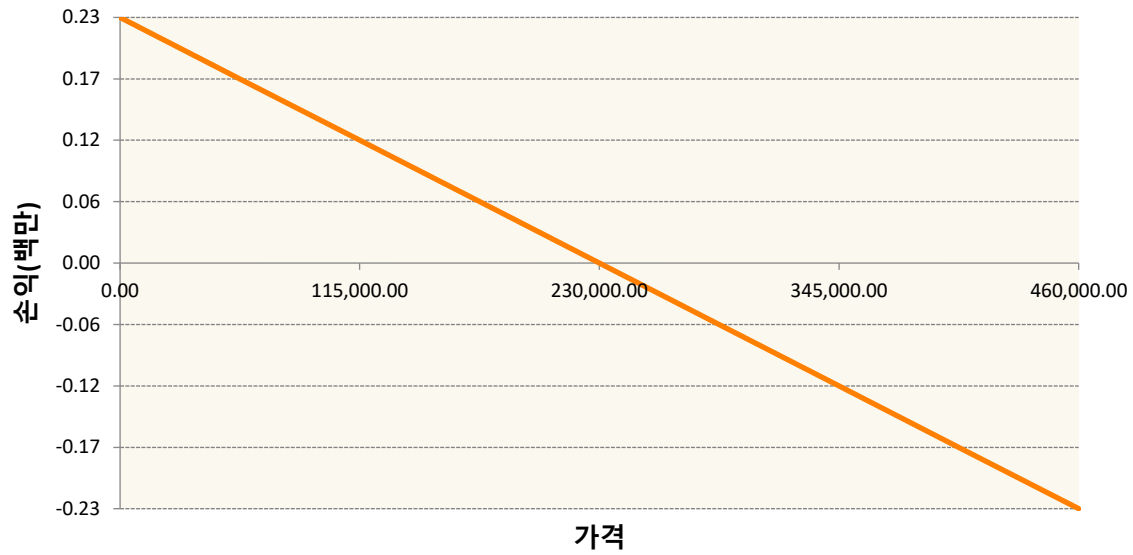
KR41CFV10002-2024-01 카카오개별선물



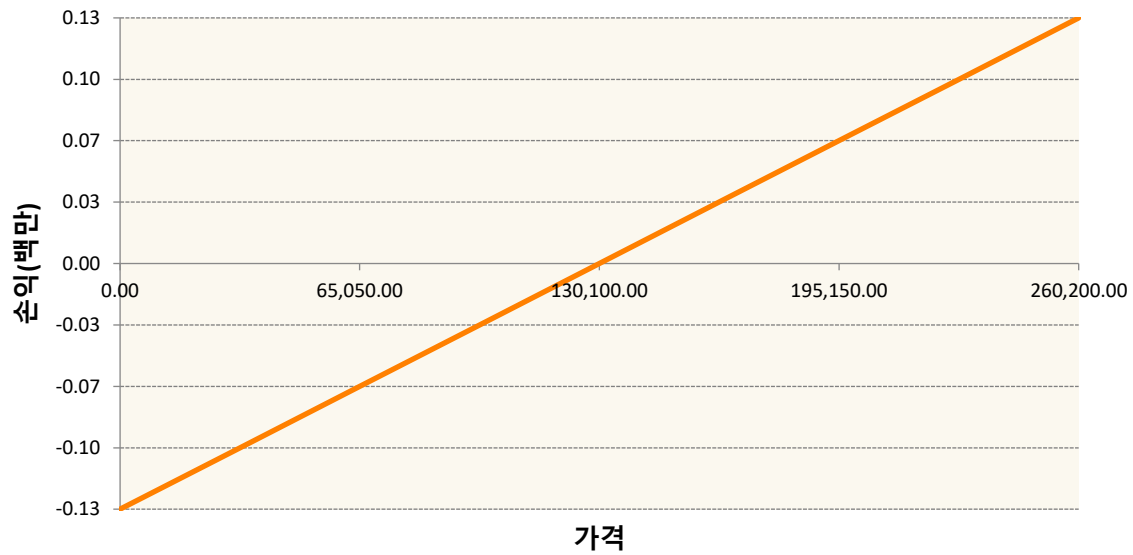
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



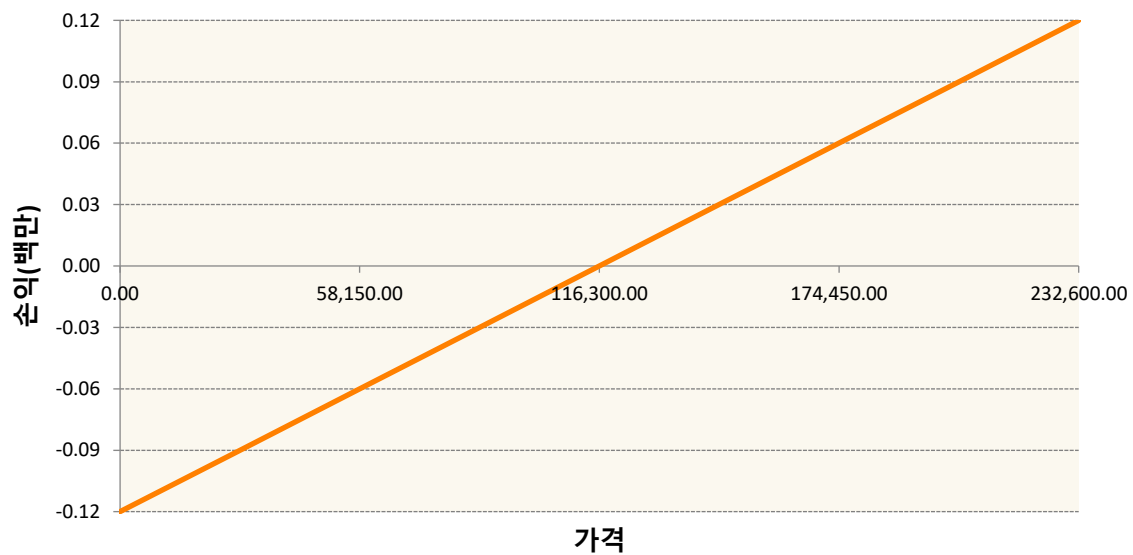
KR41CPV10001-2024-01 셀트리온개별선물



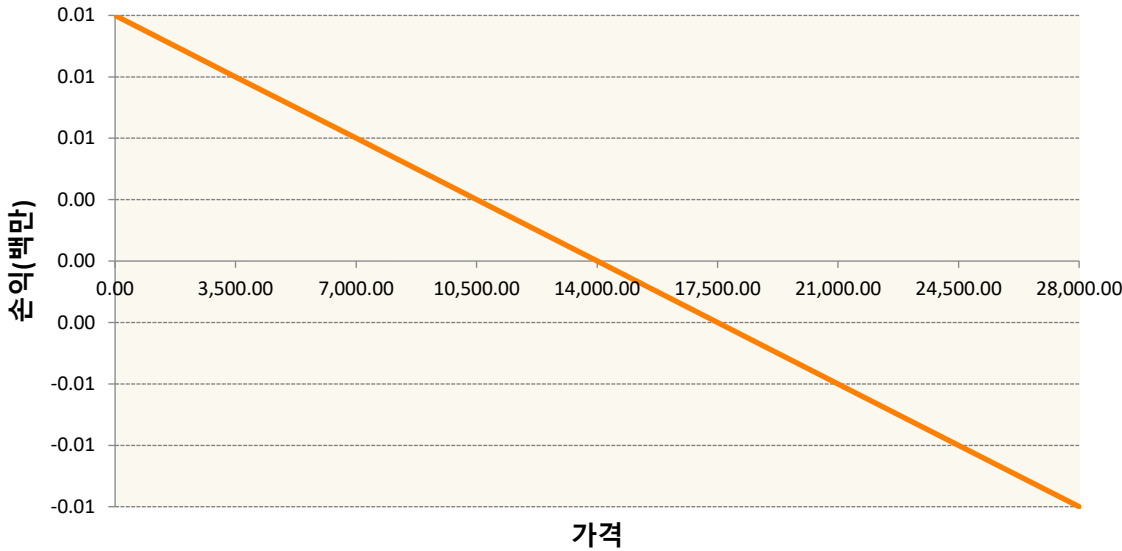
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



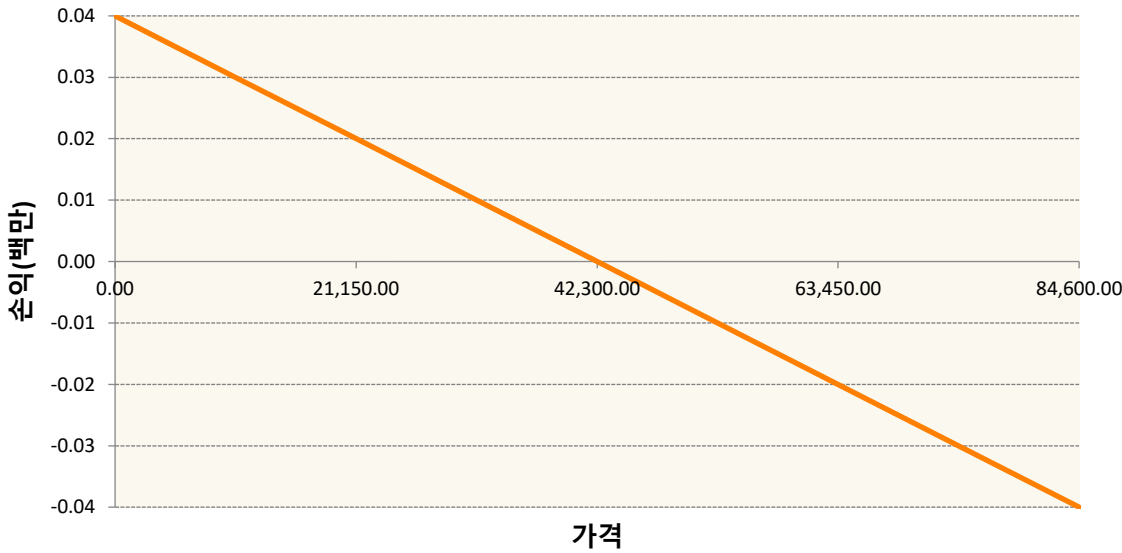
KR41DKV10000-2024-01 코스맥스개별선물



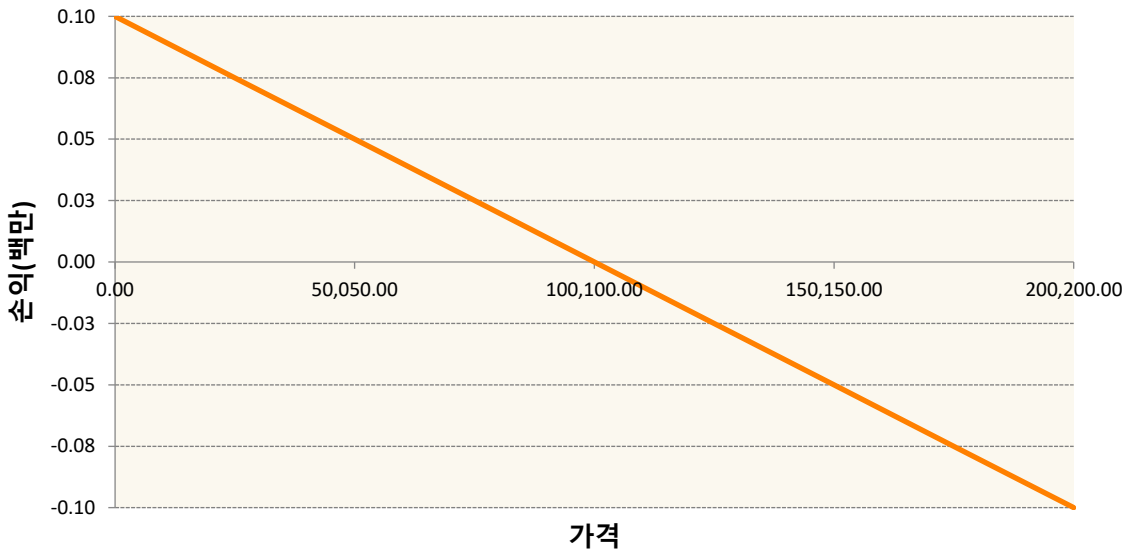
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



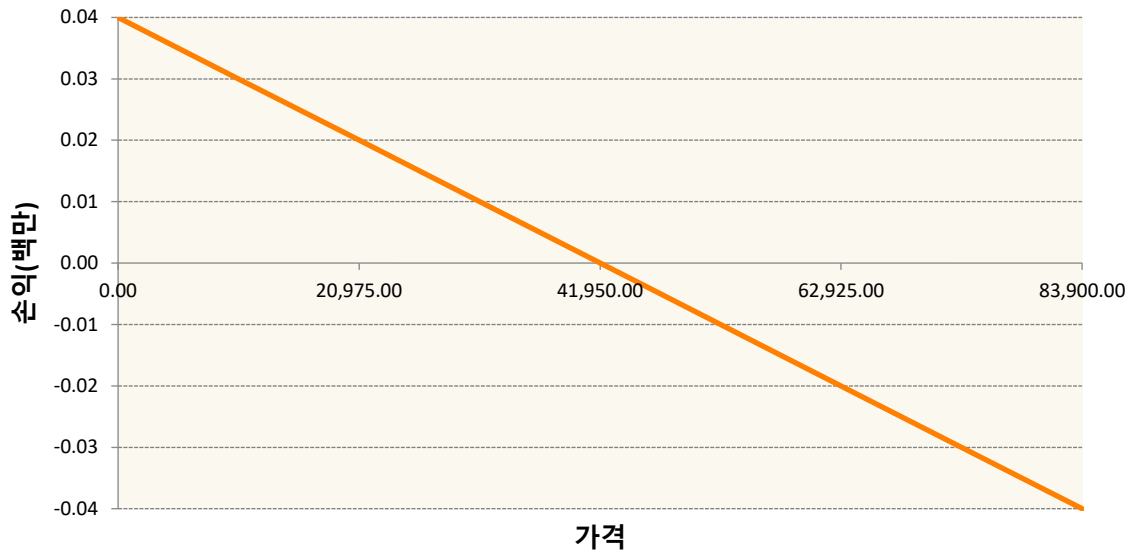
KR41EEV10001-2024-01 한올바이오파마개별선물



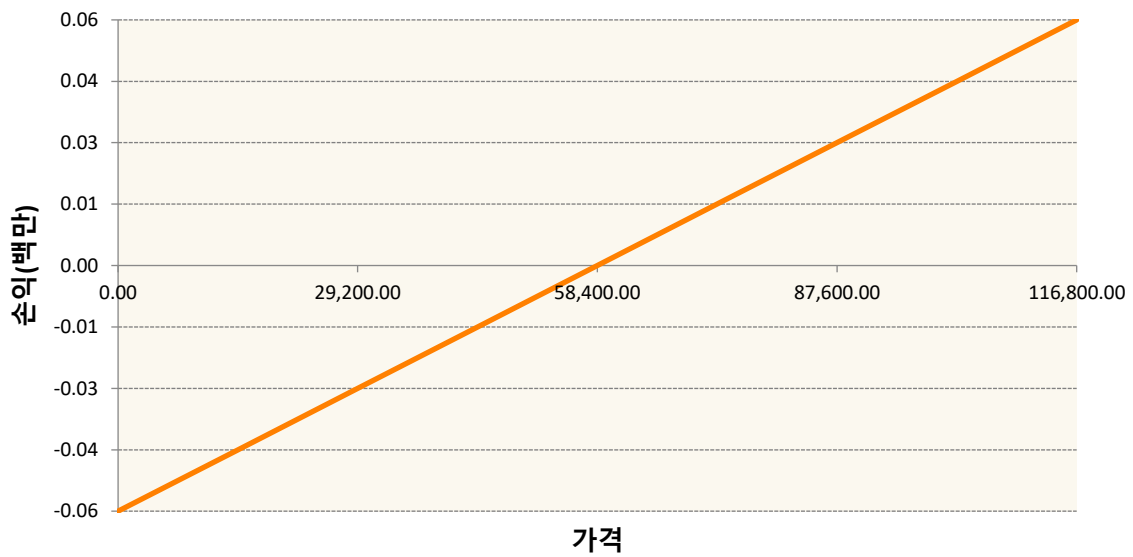
KR41EFV10008-2024-01 JYP Ent.개별선물



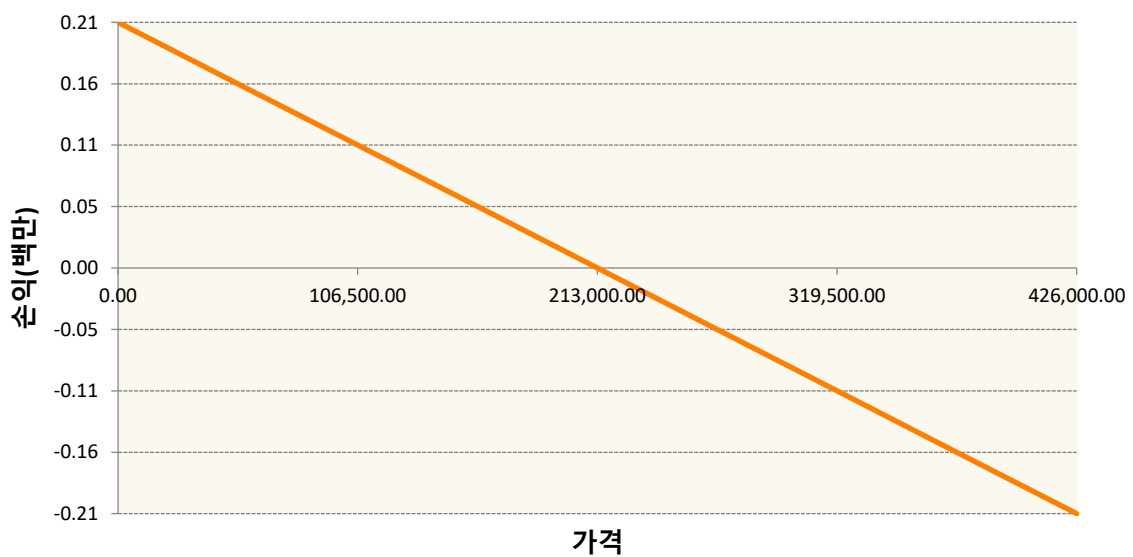
KR41ENV10002-2024-01 동진세미캠개별선물



KR41FKV10005-2024-01 메리츠금융지주개별선물



KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물		99
KR4116V100 2024-01 현대차개별선물		3
KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물		2
KR41CFV100 2024-01 카카오개별선물		0.36
KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물		8
KR41CPV100 2024-01 셀트리온개별선물		4
KR41DBV100 2024-01 LG넥스원개별선물		2
KR41DKV100 2024-01 코스맥스개별선물		0.28
KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물		1
KR41EEV100 2024-01 한올바이오파마개별선물		1
KR41EFV100 2024-01 JYP Ent.개별선물		2
KR41ENV100 2024-01 동진세미캠개별선물		0.34
KR41FKV100 2024-01 메리츠금융지주개별선물		0.05
KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	154

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

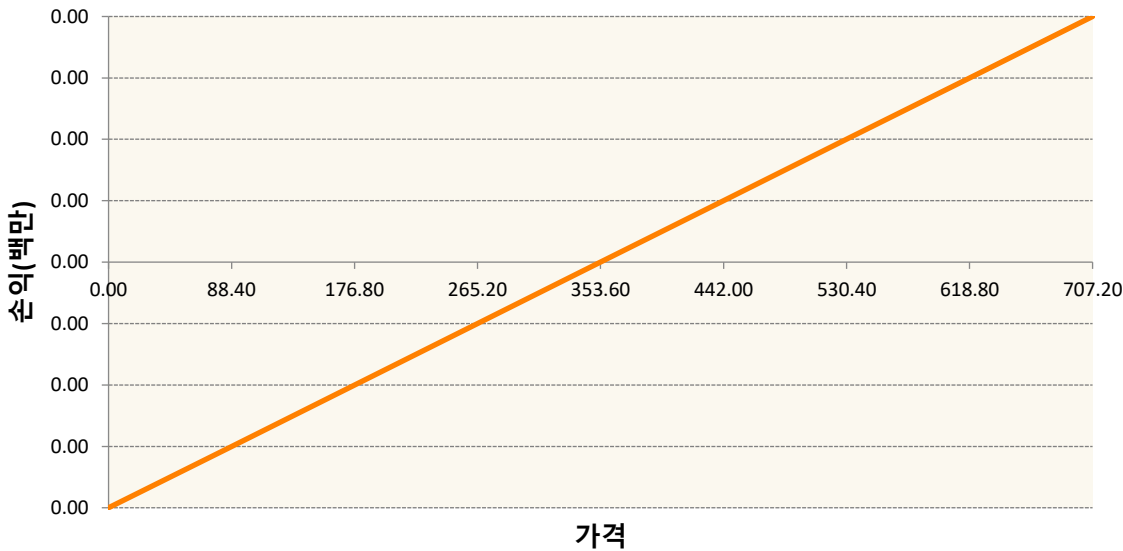
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,182	0	3,182	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101V30005		2024-03 코스피200지수선물					253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

233

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

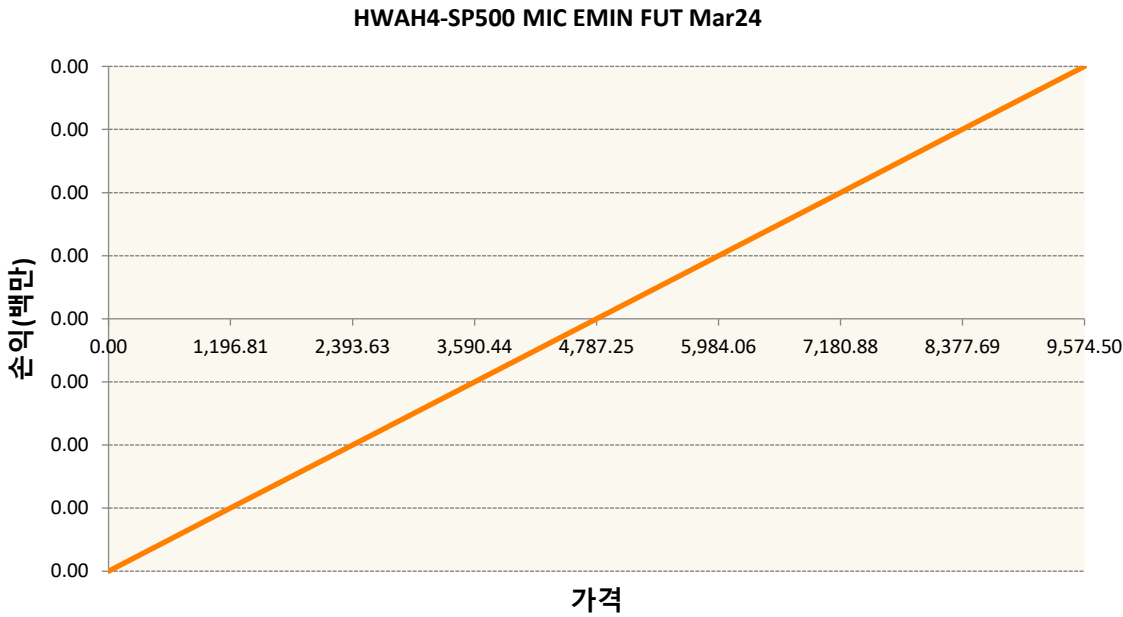
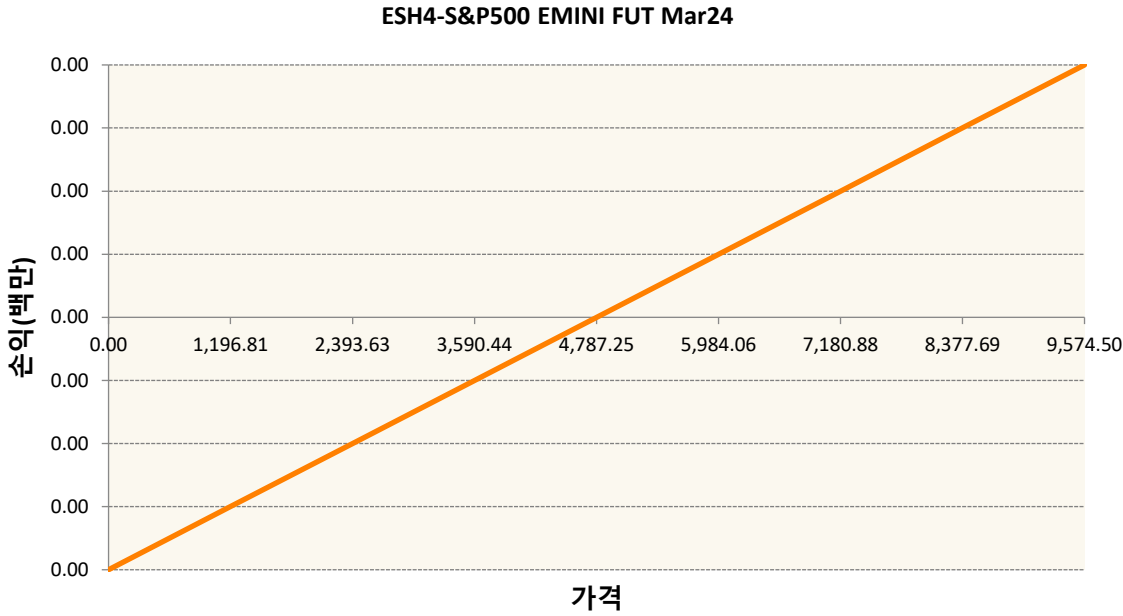
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	932	0	932	
누계	유가증권	선물	2,574	0	2,574	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH4	S&P500 EMINI FUT Mar24	75
HWAH4	SP500 MIC EMIN FUT Mar24	206

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	234

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

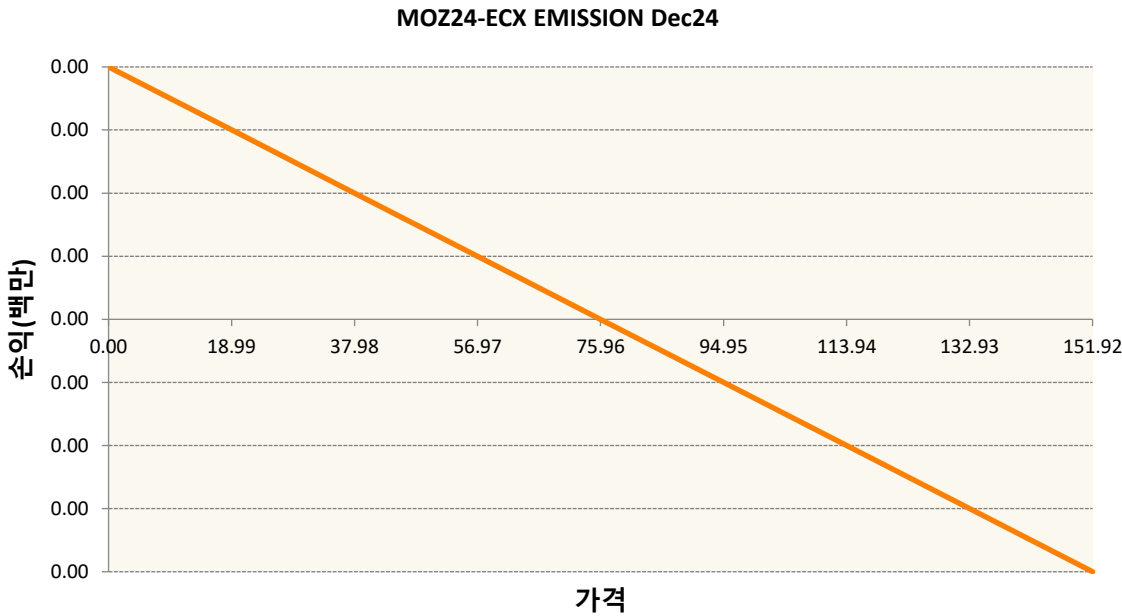
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	5,747	-5,747	
누계	지수	스왑	424	0	424	장외
누계	통화	선도	0	1,332	-1,332	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E	107
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	460
SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

904

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

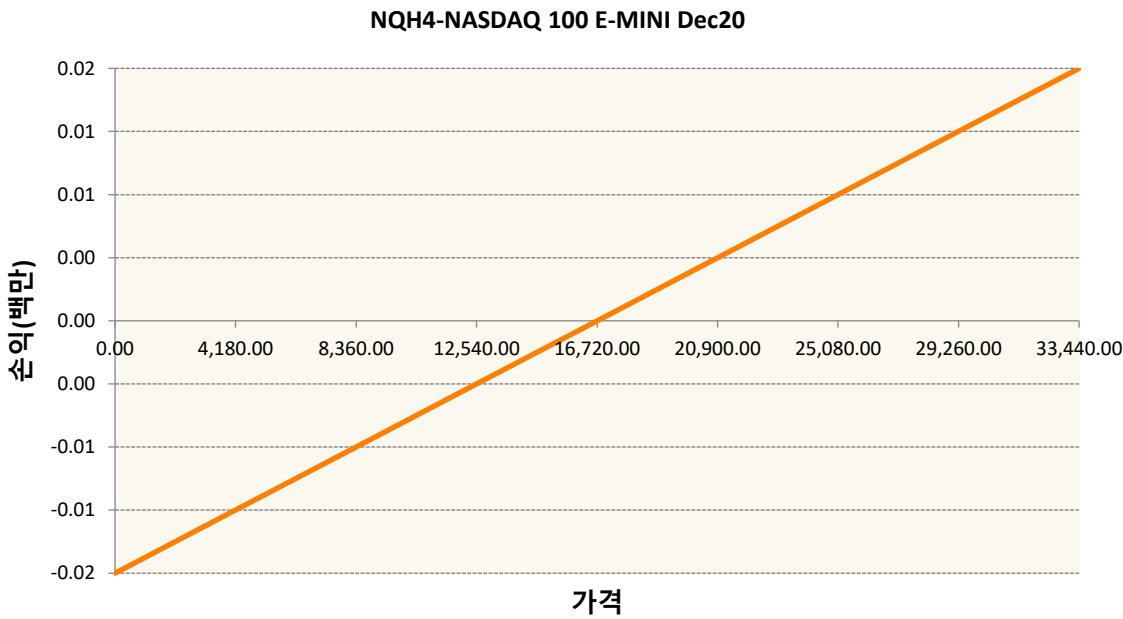
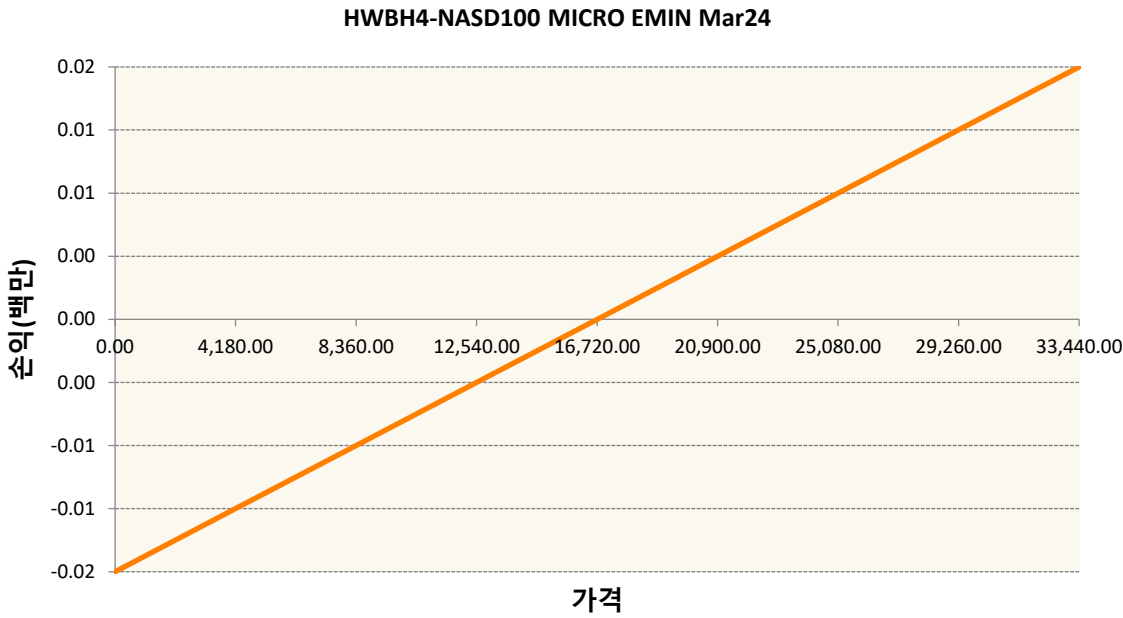
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,733	0	1,733	
누계	유가증권	선물	2,328	0	2,328	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH4	NASD100 MICRO EMIN Mar24		186
NQH4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		139

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			308

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	5,532	0	5,532	장외
누계	지수	스왑	11,508	0	11,508	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	80
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	161
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	161
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	80
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	362
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	80

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

643

공시일	2024-01-04
기준일	2024-01-03

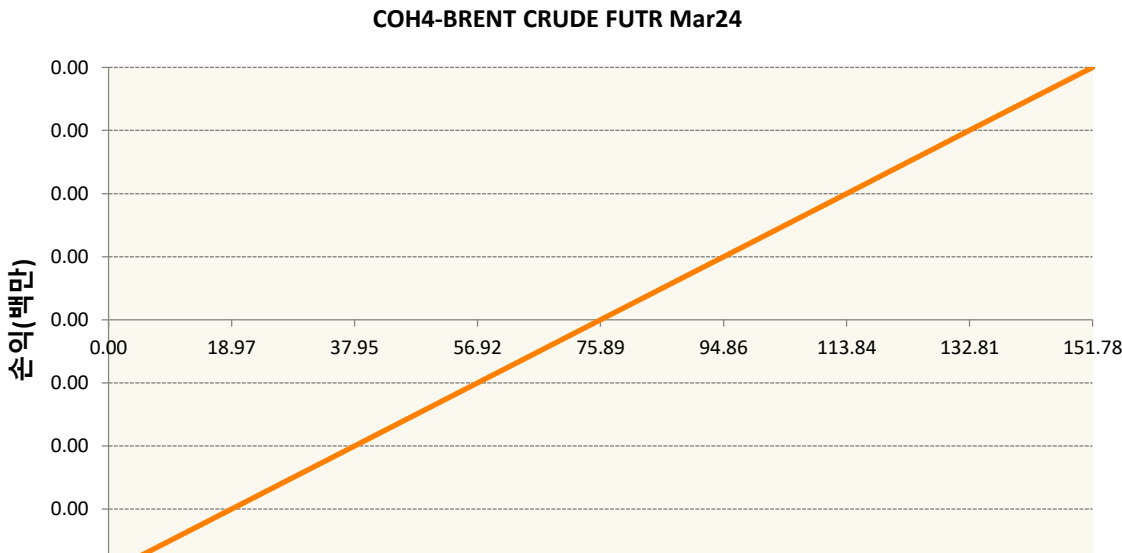
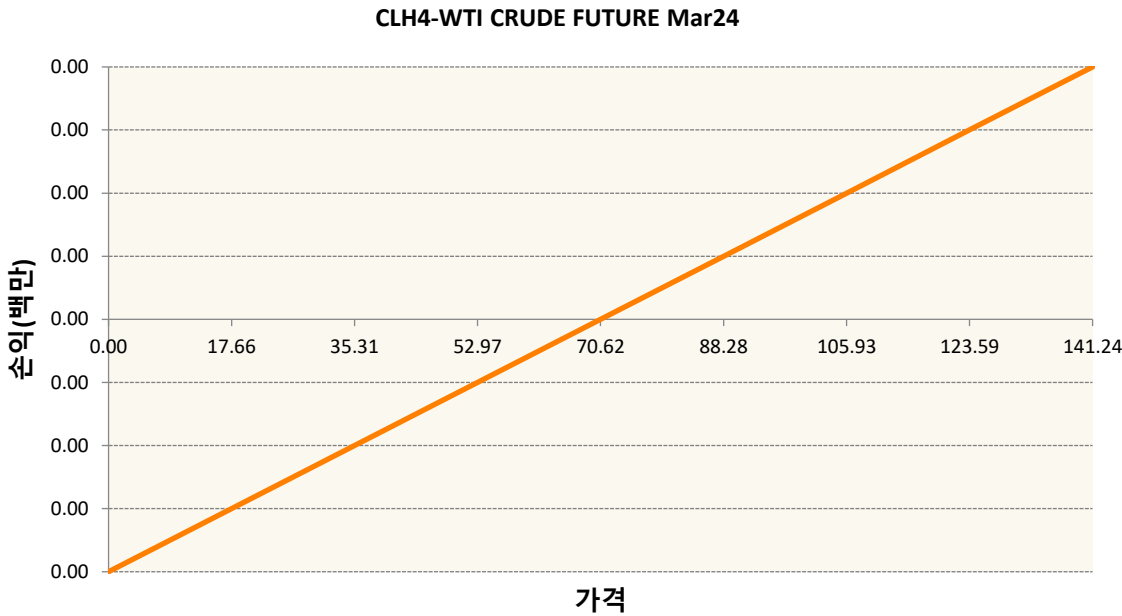
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

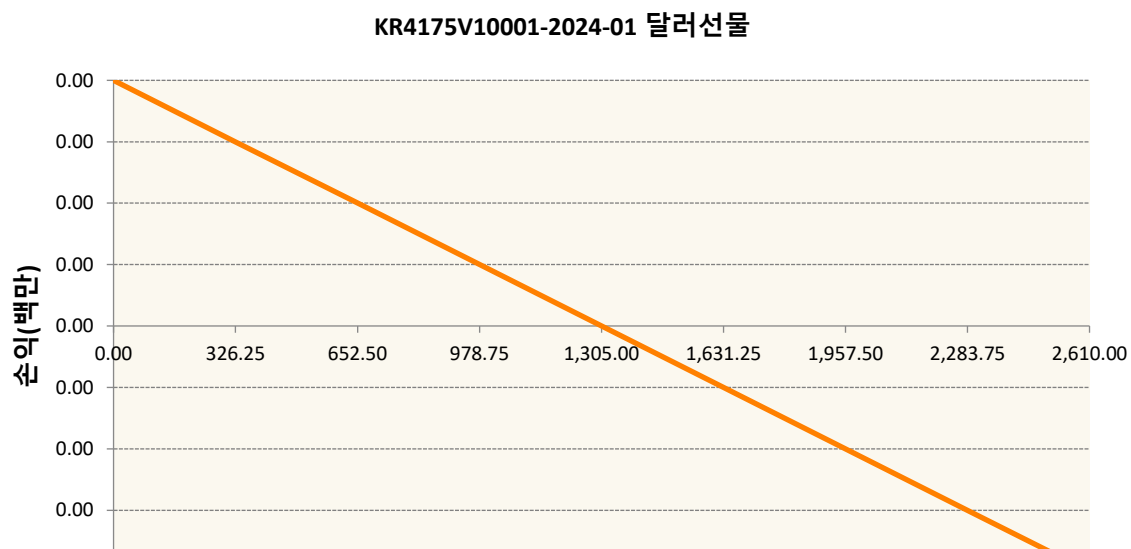
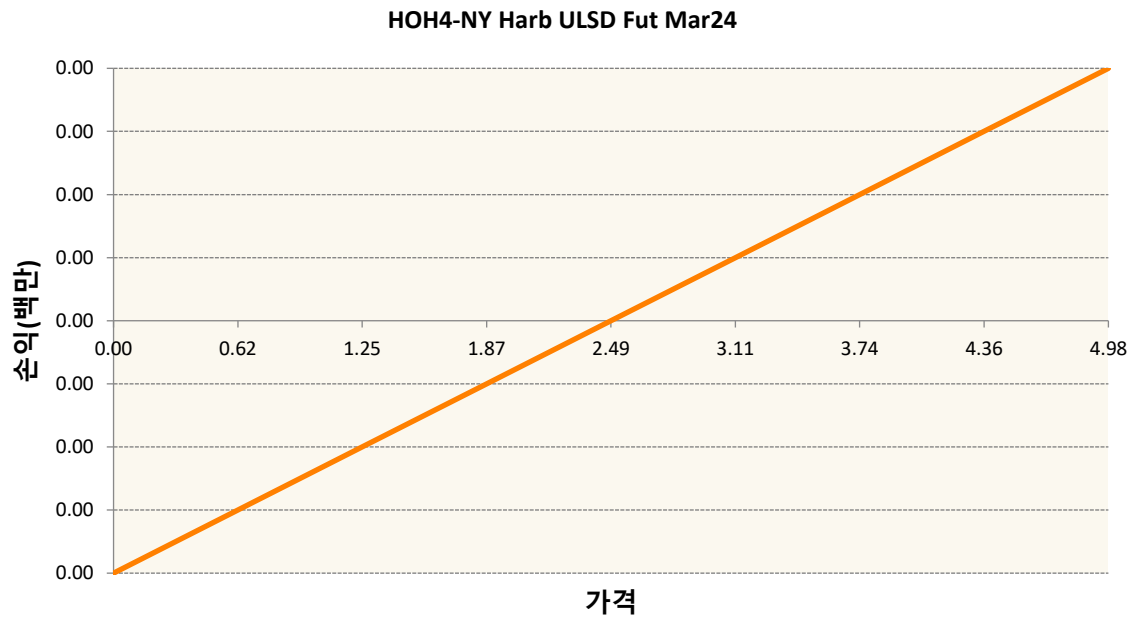
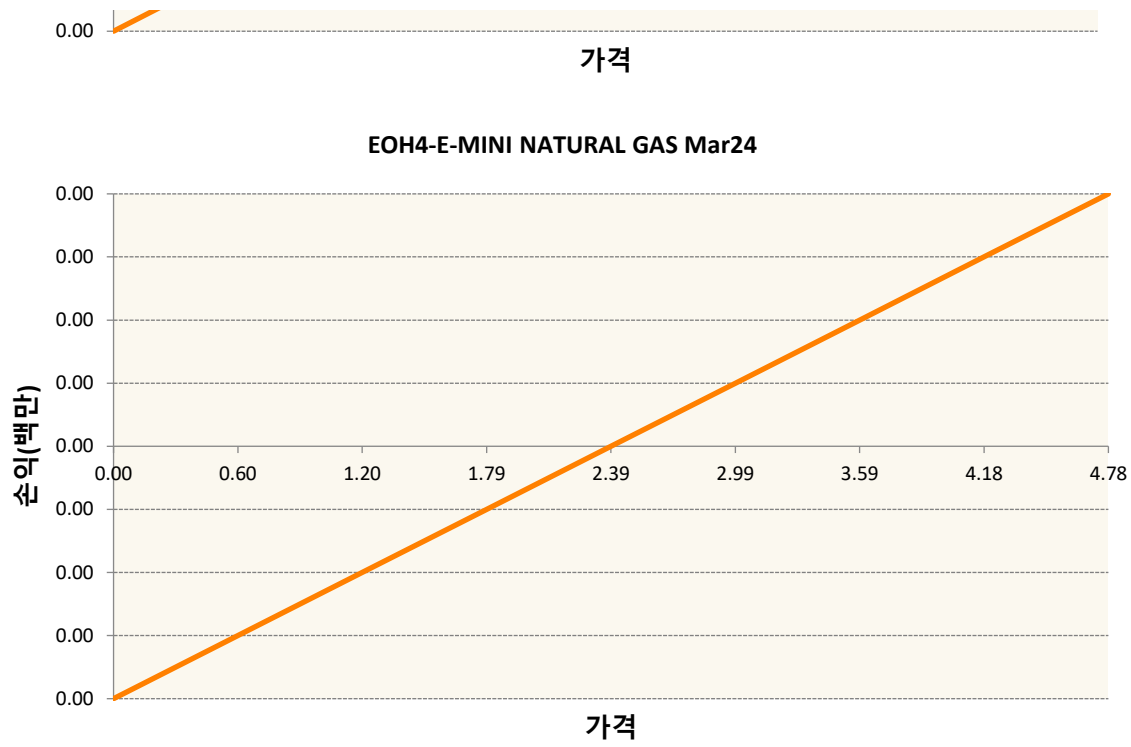
1. 계약금액

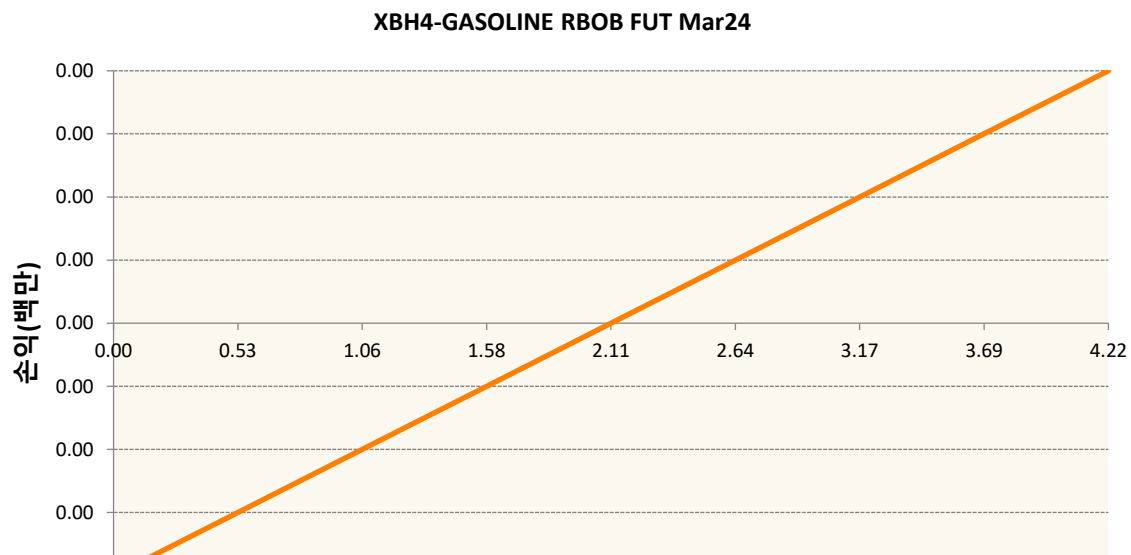
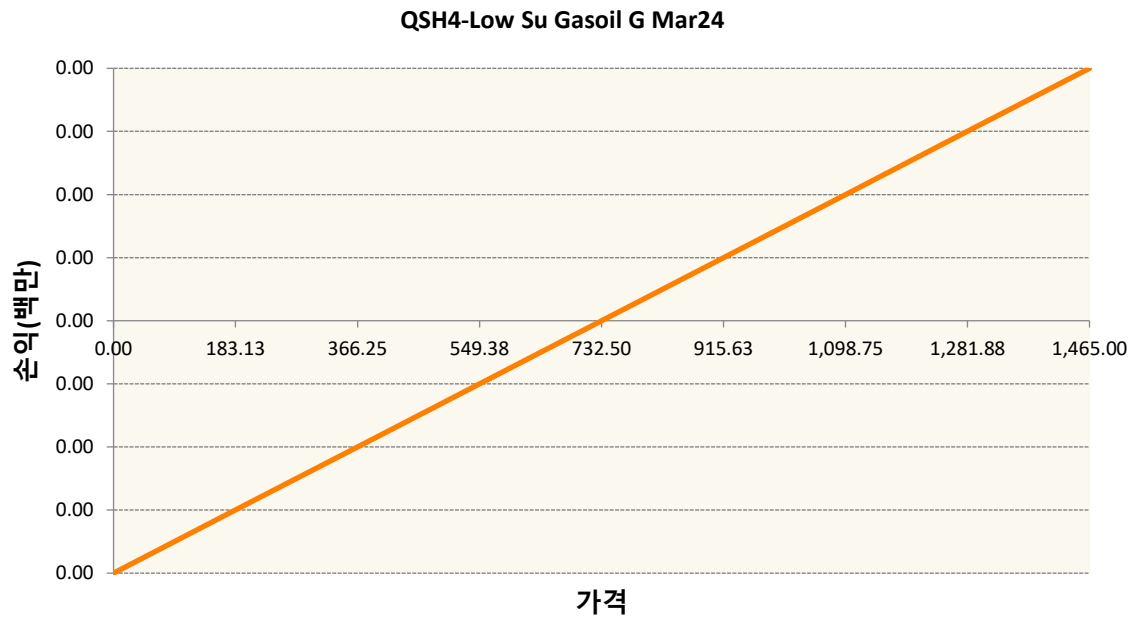
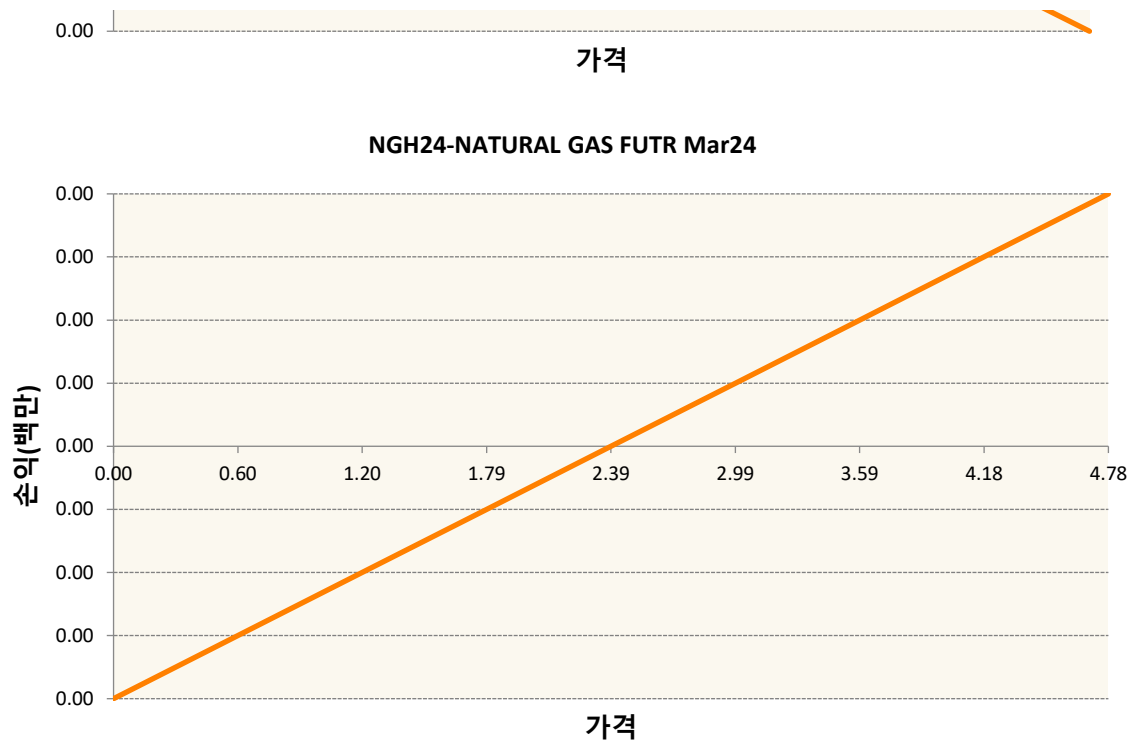
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	13	0	13	장내
누계	선물	유가증권	278	0	278	
누계	유가증권	선물	862	0	862	
누계	통화	선물	0	157	-157	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH4	WTI CRUDE FUTURE Mar24	22
COH4	BRENT CRUDE FUTR Mar24	24
EOH4	E-MINI NATURAL GAS Mar24	2
HOH4	NY Harb ULSD Fut Mar24	11
KR4175V100 2024-01 달러선물		13
NGH24	NATURAL GAS FUTR Mar24	15
QSH4	Low Su Gasoil G Mar24	8
XBH4	GASOLINE RBOB FUT Mar24	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	219